BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERÚ

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS

(Millones de Soles)

	06 Mayo 19	07 Mayo 19	08 Mayo 19	09 Mayo 19	10 Mayo 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	**3 928,7**	**4 258,3**	**4 379,8**	**6 283,2**	**5 005,4**
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)	50.0	300.0	50.0 300.0	50.0 300.0 300.0	300.0 300.0
Propuestas recibidas	286.0	1088.0	217.0 783.5	298.2 720.2 683.0	1038.0 763.0
Plazo de vencimiento	182 d	181 d	545 d 363 d	362 d 362 d 179 d	361 d 178 d
Tasas de inter Mínima	2.50	2.48	2.79 2.68	2.66 2.66 2.47	2.68 2.51
Máxima	2.51	2.53	2.80 2.69	2.68 2.69 2.53	2.70 2.55
Promedio	2.50	2.51	2.79 2.68	2.67 2.68 2.51	2.68 2.54
Saldo	26 217.5	26 517.5	26 892.5	25 629.5	26 229.5
Próximo vencimiento de CD BCRP el 6 de junio de 2019	2 208.0		2 208.0		1 585.0
Vencimiento de CD BCRP del 13 al 17 de mayo de 2019	2 208.0		2 208.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)	250.0				
Propuestas recibidas	1000.0				
Plazo de vencimiento	1 d				
Tasas de inter Mínima	2.95				
Máxima	3.12				
Promedio	3.06				
Saldo	6 000.0	5 750.0	5 750.0	5 750.0	5 750.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 21 de mayo de 2019	250.0		200.0		200.0
Vencimiento de REPO BCRP del 13 al 17 de mayo de 2019	250.0		0.0		0.0
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Vencimiento de CDLD BCRP del 13 al 17 de mayo de 2019	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional			200.0	800.1 621.0	1000.0
Propuestas recibidas			631.1	822.4 621.0	1447.8
Plazo de vencimiento			1 d	7 d 1 d	3 d
Tasas de inter Mínima			2.16	2.33 2.28	2.38
Máxima			2.42	2.75 2.75	2.75
Promedio			2.31	2.68 2.58	2.53
Saldo	0.0	0.0	200.0	1 421.1	1 800.1
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 13 de mayo de 2019	0.0		200.0		1 000.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 13 al 17 de mayo de 2019	0.0		200.0		1 800.1
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4 400.0	4 400.0	4 400.0	4 400.0	4 400.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 20 de junio de 2019	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de Coloc-TP del 13 al 17 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de CDR BCRP del 13 al 17 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	10 953.1	10 953.1	10 953.1	10 953.1	10 953.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 03 de junio de 2019	400.0		400.0		400.0
Vencimiento de REPO del 13 al 17 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Expansion el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de REPO Expansión del 13 al 17 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Sustitucion el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 13 al 17 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Venta el					
Vencimiento de SC - Venta del 13 al 17 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de inter Mínima					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de SC - Compra del 13 al 17 de mayo de 2019	0.0		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US$)					
Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US$)	0.0	2.7	0.0	0.0	0.0
i. Compras (millones de US$) - Tesoro Público		2.7			
ii. Ventas (millones de US$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR					
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	**4 128,7**	**3 958,3**	**3 829,8**	**4 212,1**	**3 405,4**
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).					
Comisión (tasa efectiva diaria)	0.0076%	0.0076%	0.0076%	0.0076%	0.0086%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%	3.30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés					
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	0.0	110.0	70.0	32.2	0.0
Tasa de interés	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	**4 128,7**	**3 848,3**	**3 759,8**	**4 179,9**	**3 405,4**
r. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/) (*)	9 170,8	9 179,6	9 199,1	9 227,8	9 267,7
t. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	6,0	6,0	6,0	6,1	6,1
r. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3 725,0	3 719,0	3 735,2	3 774,7	3 815,2
r. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	2,4	2,4	2,4	2,5	2,5
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	835.7	829.5	869.5	803.6	915.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75	2.75/2.75/2.75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US$)	0.0	0.0	0.0	0.0	25.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima/ Promedio					2.50/2.50/2.50
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	0.0	0.0	0.0	0.0	5.2
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)					
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)					5.2 / 2.68
Plazo 18 meses (monto / tasa promedio)					
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US$)	**03 Mayo 19**	**06 Mayo 19**	**07 Mayo 19**	**08 Mayo 19**	**09 Mayo 19**
Flujo de la posición global = a + b.i - c.i + e + f + g	-208,3	148,0	54,1	-191,1	18,4
Flujo de la posición contable = a + b.ii - c.ii + e + g	-169,5	137,4	60,6	-285,4	-17,7
a. Mercado spot con el público	-177,1	53,6	44,1	-289,2	-4,5
i. Compras	287,7	283,1	292,9	416,1	356,2
ii (-) Ventas	464,8	229,5	248,7	705,2	360,7
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	89,3	-108,4	137,8	162,2	36,0
i. Pactadas	215,3	111,6	165,3	204,0	260,1
ii (-) Vencidas	126,0	219,9	27,5	41,8	246,1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	134,3	-121,6	142,1	68,2	0,0
i. Pactadas	307,5	156,1	343,5	428,4	394,3
ii (-) Vencidas	173,1	277,7	201,5	360,2	394,3
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	533,8	405,4	547,2	492,4	504,8
ii. A futuro	70,0	55,0	32,0	8,0	7,0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	60,5	153,7	192,8	329,8	133,5
i. Compras	133,1	227,9	199,8	359,9	357,2
ii (-) Ventas	72,6	74,3	7,0	30,2	223,7
f. Efecto de Opciones	5,5	-2,7	-2,2	0,3	0,1
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	-5,7	-12,2	-2,3	-7,6	1,4
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)	3,3004	3,3112	3,3144	3,3150	3,3238

(*) Datos preliminares

Elaboración: Gerencia de Operaciones Monetarias y Estabilidad Financiera